

友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金 2009 年年度报告

2009 年 12 月 31 日

基金管理人：友邦华泰基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2010 年 03 月 26 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2010 年 3 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金（友邦增利）由友邦华泰中短期债券投资基金（友邦短债）转型而来。转型后基金合同于 2007 年 12 月 3 日生效。原友邦短债的基金份额全部转为友邦增利的 A 类份额，友邦增利的 B 类份额于 2008 年 1 月 9 日开始销售。

本报告期自 2009 年 1 月 1 日起至 2009 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其它相关资料.....	6
3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	11
4 管理人报告.....	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
5 托管人报告.....	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本年度报告/半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
6 审计报告.....	15
7 年度财务报表.....	15
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4 报表附注.....	19
8 投资组合报告.....	37
8.1 期末基金资产组合情况.....	37
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	38
8.4 报告期内权益投资组合的重大变动.....	39
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	40
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	41
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	41
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	41
8.9 投资组合报告附注.....	41
9 基金份额持有人信息.....	42

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	42
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	43
10 开放式基金份额变动.....	43
11 重大事件揭示.....	43
11.1 基金份额持有人大会决议	43
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	43
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	44
11.4 基金投资策略的改变.....	44
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	44
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	44
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	44
11.8 其它重大事件.....	45
12 备查文件目录.....	47

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	友邦华泰金字塔稳本增利债券型基金	
基金简称	友邦华泰稳本增利债券	
基金主代码	519519	
交易代码	519519	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2007 年 12 月 3 日	
基金管理人	友邦华泰基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	402,132,543.96 份	
基金合同存续期	不定期	
下属两级的基金简称:	友邦华泰金字塔稳本增利债券型基金 A	友邦华泰金字塔稳本增利债券型基金 B
下属两级的交易代码:	519519	460003
报告期末下属两级基金的份额总额	240,664,049.11 份	161,468,494.85 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制本金下跌风险的前提下,充分利用资本市场各类资产定价不准确产生的投资机会,实现基金资产的持续稳定增值。	
投资策略	本基金将以固定收益类资产投资为基础,以其投资收益为保障,参照固定比例组合保险机制(CPPI)对风险类资产上限进行动态调整,以有效保障投资组合本金的安全。	
业绩比较基准	中信全债指数×80%+一年期银行定期存款税后收益率×20%	
风险收益特征	属于主动管理的债券型基金,较低风险较低收益。	
	A 类	B 类
下属两级基金的风险收益特征	属于主动管理的债券型基金,较低风险较低收益。	属于主动管理的债券型基金,较低风险较低收益。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		友邦华泰基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈晖	张燕
	联系电话	021-38601777	0755-83199084
	电子邮箱	cs4008880001@aig-huatai.com	yan_zhang@cmbchina.com

客户服务电话	400-888-0001	95555
传真	021-38601799	0755-83195201
注册地址	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层	深圳深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层	深圳深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	200135	518040
法定代表人	齐亮	秦晓

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.aig-huatai.com
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

2.5 其它相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限公司	上海湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区金融大街 27 号投资广场 22-23 层
	友邦华泰基金管理有限公司	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

2009年		
3.1.1 期间数据和指标	A类	B类
本期已实现收益	18,775,252.82	19,104,315.28
本期利润	11,254,567.01	12,542,055.80
加权平均基金份额本期利润	0.0589	0.0582
本期基金加权平均净值利润率	5.34%	5.31%
本期基金份额净值增长率	5.98%	5.64%
3.1.2 期末数据和指标	2009年末	
期末可供分配利润	19,118,354.67	11,710,896.21

期末可供分配基金份额利润	0.0794	0.0725
期末基金资产净值	260,479,717.49	173,650,516.00
期末基金份额净值	1.0823	1.0754
3.1.3 累计期末指标	2009年末	
基金份额累计净值增长率	19.97%	19.25%
2008年		
3.1.1 期间数据和指标	A类	B类
本期已实现收益	49,011,210.54	25,095,354.11
本期利润	58,636,464.57	32,683,743.31
加权平均基金份额本期利润	0.0707	0.0738
本期基金加权平均净值利润率	6.89%	7.20%
本期基金份额净值增长率	9.37%	9.06%
3.1.2 期末数据和指标	2008年末	
期末可供分配利润	22,964,391.95	20,284,627.35
期末可供分配基金份额利润	0.0723	0.0692
期末基金资产净值	347,840,533.66	320,208,076.86
期末基金份额净值	1.0955	1.0924
3.1.3 累计期末指标	2008年末	
基金份额累计净值增长率	13.20%	12.88%
2007年		
3.1.4 期间数据和指标	A类	B类
本期已实现收益	444,593.85	—
本期利润	1,266,186.99	—
加权平均基金份额本期利润	0.0097	—
本期基金加权平均净值利润率	0.96%	—
本期基金份额净值增长率	0.98%	—
3.1.5 期末数据和指标	2007年末	
期末可供分配利润	1,535,664.31	—
期末可供分配基金份额利润	0.0119	—
期末基金资产净值	131,590,242.80	—
期末基金份额净值	1.0176	—
3.1.6 累计期末指标	2007年末	
基金份额累计净值增长率	0.98%	—

注：1、本基金于 2007 年 12 月 3 日由友邦华泰中短期债券投资基金（友邦短债）转型为友邦华

泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金（友邦增利）。原友邦短债基金的基金份额全部转为 A 类份额，B 类基金份额于 2008 年 1 月 9 日开始销售。本报告列示的 2007 年度期间数据和指标、基金份额累计净值增长率的计算区间均为 2007 年 12 月 3 日至 2007 年 12 月 31 日。2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

分级 A

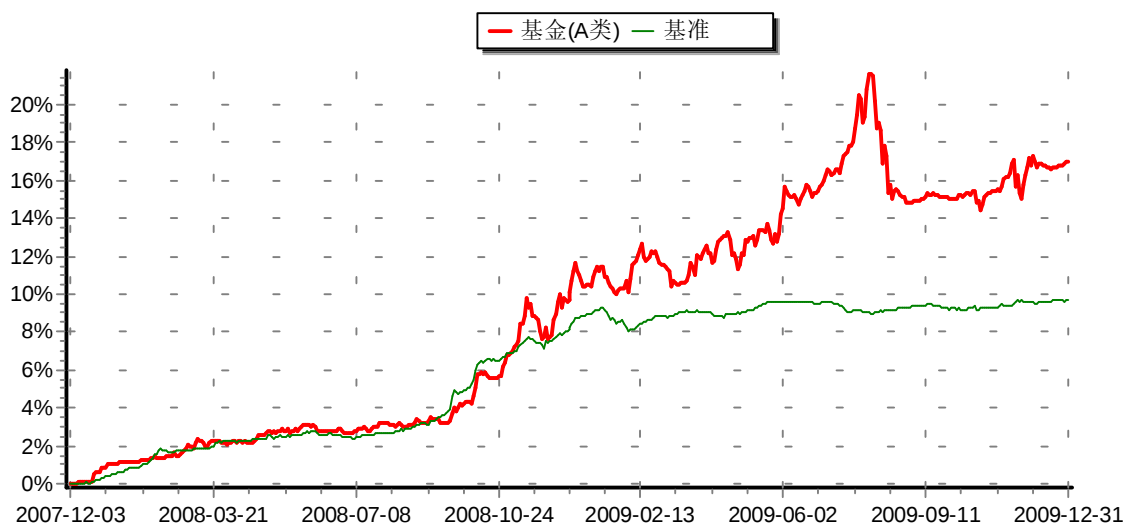
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.73%	0.30%	0.40%	0.04%	1.33%	0.26%
过去六个月	1.09%	0.40%	0.11%	0.04%	0.98%	0.36%
过去一年	5.98%	0.36%	0.67%	0.05%	5.31%	0.31%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今 (2007 年 12 月 03 日-2009 年 12 月 31 日)	17.06%	0.28%	9.68%	0.07%	7.38%	0.21%

分级 B

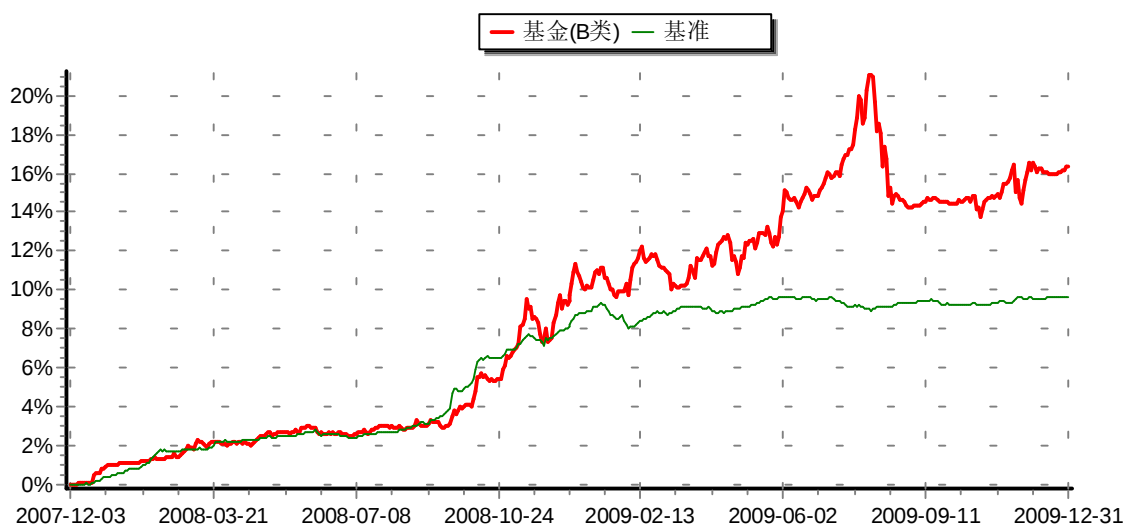
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.64%	0.30%	0.40%	0.04%	1.24%	0.26%
过去六个月	0.92%	0.40%	0.11%	0.04%	0.81%	0.36%
过去一年	5.64%	0.36%	0.67%	0.05%	4.97%	0.31%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今 (2007 年 12 月 03 日-2009 年 12 月 31 日)	16.35%	0.28%	9.68%	0.07%	6.67%	0.21%

注：本基金的业绩基准由中信全债指数和一年期银行定期存款税后收益率按照 80%与 20%之比构建，并每日进行再平衡；

3.2.2 自基金转型以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



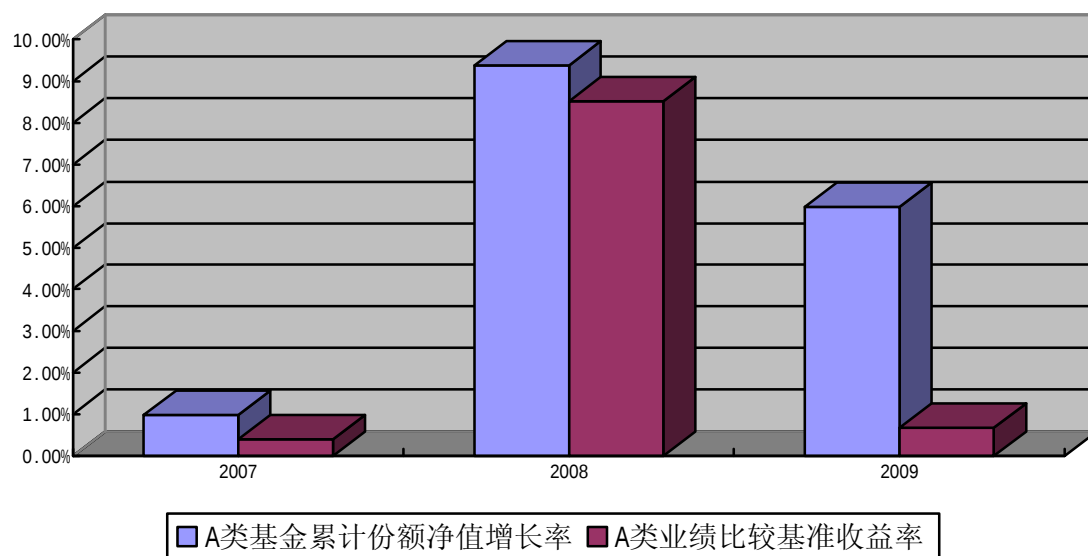
注：图示日期为2007年12月3日至2009年12月31日。



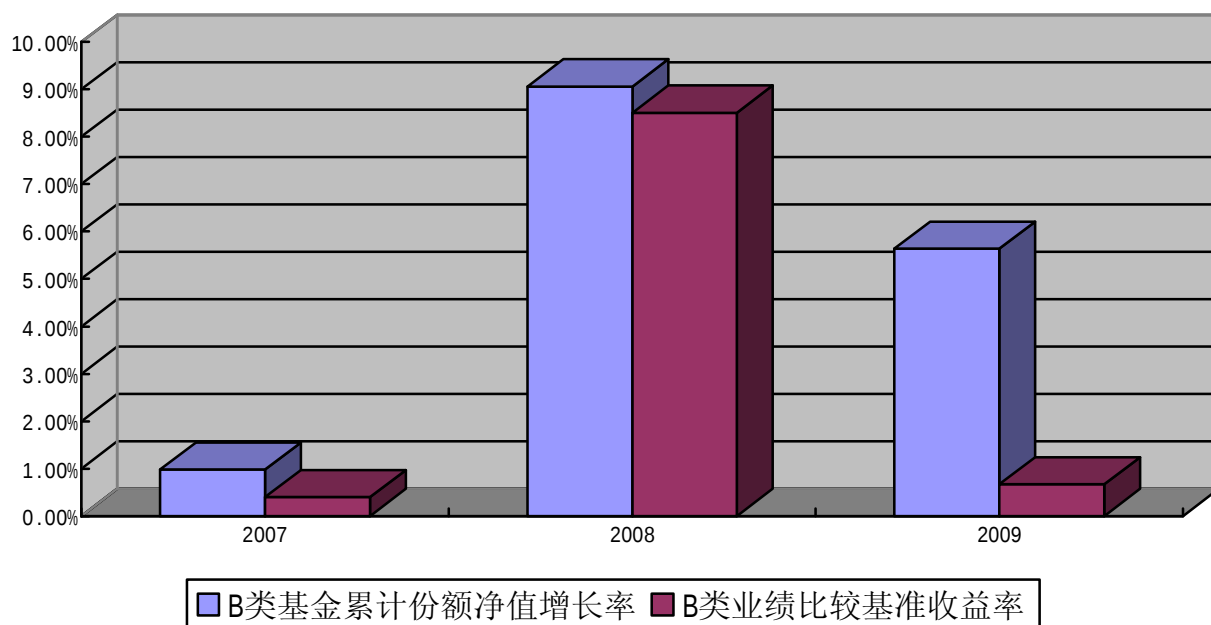
注：图示日期为2007年12月3日至2009年12月31日。

- 1、本基金于2007年12月3日由友邦华泰中短期债券投资基金转型为友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金。
- 2、按转型后基金合同规定，本基金自转型日起6个月内为建仓期，截至报告日本基金的各项投资比例已达到转型后基金合同第十三条（二）投资范围中规定的各项比例，投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%，投资于风险类资产（固定收益类资产以外的其它资产，包括股票、权证等）的比例不超过基金资产的20%。

3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：基金转型合同于2007年12月3日生效，2007年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。



注：基金转型合同于2007年12月3日生效，2007年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

- 1、本基金于2007年12月3日由友邦华泰中短期债券投资基金转型为友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金。
- 2、按转型后基金合同规定，本基金自转型日起6个月内为建仓期，截至报告日本基金的各项投

资比例已达到转型后基金合同第十三条（二）投资范围中规定的各项比例，投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于风险类资产（固定收益类资产以外的其它资产，包括股票、权证等）的比例不超过基金资产的 20%。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

A 类					
年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2009 年	0.770	10,025,069.17	5,557,828.32	15,582,897.49	4 月 20 日、12 月 28 日实施
2008 年	0.160	406,693.71	1,658,188.75	2,064,882.46	1 月 8 日实施
2007 年	0.130	1,111,333.31	1,355,816.25	2,467,149.56	3 月 5 日、6 月 25 日、9 月 24 日实施
合计	1.06	11,543,096.19	8,571,833.32	20,114,929.51	

B 类					
年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2009 年	0.770	11,183,305.99	4,625,175.47	15,808,481.46	4 月 20 日、12 月 28 日实施
合计	0.770	11,183,305.99	4,625,175.47	15,808,481.46	

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为友邦华泰基金管理有限公司。友邦华泰基金管理有限公司是经中国证监会批准，于 2004 年 11 月 18 日成立的合资基金管理公司，注册资本为 2 亿元人民币。股东构成为 AIG Global Investment Corp.、华泰证券股份有限公司和苏州新区高新技术产业股份有限公司，出资额分别为 49%、49%和 2%。目前公司旗下管理友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金、友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、友邦华泰积极成长混合型证券投资基金、友邦华泰价值增长股票型证券投资基金、友邦华泰货币市场证券投资基金、友邦华泰行业领先股票型证券投资基金。截至 2009 年 12 月 31 日，公司基金管理规模为 220.68 亿元。

注：公司外方股东 AIG Global Investment Corp. (美国国际集团投资股份有限公司或简称“AIGGIC”)因重组原因，已于 2009 年 12 月 31 日并入 PineBridge Investments LLC (柏瑞投资有限责任公司或简称“PineBridge Investments”)，因此 AIGGIC 的名称变为“PineBridge Investments LLC”。公司已将外方股东的上述变动情况及股东更名报告材料上报中国证监会，目前尚待批准。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
沈涛	本基金的基金经理	2008 年 03 月 04 日	-	16 年	沈涛先生，经济学博士。2005 年 9 月至 2007 年 11 月任易方达基金管理有限公司月月收益中短期债券投资基金基金经理。2007 年 11 月加入友邦华泰基金管理有限公司，2008 年 3 月起任友邦华泰金字塔稳本增利债券型基金基金经理，2009 年 5 月起兼任友邦华泰货币市场基金基金经理。

注：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。任职日期和离职日期指基金管理公司作出决定之日。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及其他相关法律、法规的规定以及《友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金基金合同》的约定，在严格控制风险的基础上，忠实履行基金管理职责，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金投资管理符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，通过科学完善的制度及流程，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。首先投资部和研究部通过规范的决策流程来确保公平对待不同投资组合。其次集中交易室对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，在交易过程中启用投资交易系统内的公

平交易模块，确保公平交易的实施。同时，风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估。本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 本投资组合与其它投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金与本基金管理人旗下的其他投资组合的投资风格均不相同。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在整个09年，A股震荡向上，反映了中国经济率先从金融危机中复苏的良好预期。上半年，随着08年底09年初的多项政策一一落实，经济V型反转的趋势越来越明朗，投资者信心也越来越得到加强；而下半年开始，随着复苏的状态被越来越多的反映到上市公司的报表上，宏观政策也逐渐表示出紧缩的倾向。市场在信心和业绩的震荡中不断走强，充裕的流动性提升了整体市场的估值水平，展现了精彩的板块及个股行情，全年看平均涨幅近1倍，许多个股股价涨幅惊人。

相对而言全年债券市场在相信经济复苏的前提下震荡走低，尽管全年看CPI仍是负值，但由于经济环比增速较快，市场已经开始反映由于大量的新增信贷引起的通胀预期，随着紧缩政策的开始，部分投资者积极进入高息票的信用债市场以得到可观的持有期收益。

基金抓住市场的波动，阶段性加大了对权益类投资的比重，获得较好的正收益。除了认购新股以外，基金也进行了部分高收益债券的投资。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期末，本基金A类和B类基金份额净值分别为1.0823元和1.0754元，分别上涨5.98%和5.64%，同期本基金的业绩比较基准上涨0.67%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2010年，我们在无比坚定地确认经济复苏的同时，对可持续发展的路径却开始了争执，而通胀数据的抬头使得我们更多的怀疑流动性充沛的作用。尽管对于工业企业利润增速在上半年继续加快的观点得到越来越多的认同，但股市的表现却未必与此相同，随着央票发行利率的上升，宏观政策的收紧快于大部分投资者的预期，我们未必能期望10年的股市能有09年的收获，但毕竟我们的经济已经开始复苏，阶段性的波动行情应该还是可以期待的。

在债券市场方面，我们可能需要进一步明朗通胀的趋势，但是我们也不能排除经济复苏过程中的反复，好在09年全年市场已经提前反映了相当多的收益率上升的预期，因此对紧缩政策的反应可能不会太过激烈，市场也许能让低风险的投资者的有谨慎的乐观的条件。

本基金仍将延续稳定增长的特点，在控制风险的前提下，适当争取更多收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2009 年度，本基金管理人在为基金份额持有人谋求最大利益的同时，始终将合规运作、防范风险工作放在各项工作的首位。依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察部门按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

(1)全面开展基金运作合规监察工作，确保基金投资的独立性、公平性及合法合规

主要措施有：严格执行集中交易制度，各基金相互独立，交易指令由中央交易室统一执行完成；对基金投资交易系统事先进行合规性设置，并由风险控制部门进行实时监控，杜绝出现违规行为；严格检查基金的投资决策、研究支持、交易过程是否符合规定的程序；通过以上措施，保证了投资运作遵循投资决策程序与业务流程，保证了基金投资组合符合相关法规及基金合同规定，确保了基金投资行为的独立、公平及合法合规。

(2)开展定期和专项监察稽核工作，确保各项业务活动的合法合规

本年度公司监察稽核部门开展了对公司投资研究业务、公司自有资金投资、投资人员管理、基金销售、市场宣传、员工投资基金合规情况等项目的专项监察稽核活动。对稽核中发现问题及时发出合规提示函，要求相关部门限期整改，并对改进情况安排后续跟踪检查，确保各项业务开展合法合规。

(3)促进公司各项内部管理制度的完善

按照相关法规、证监会等监管机关的相关规定和公司业务的发展的要求，公司法律监察部及时要求各部门制订或修改相应制度，促进公司各项内部管理制度的进一步完善。

(4)通过各种合规培训提高员工合规意识

本年度公司监察稽核部门通过对公司所有新入职员工进行入职前合规培训、对基金投资管理人员进行专项合规培训、对员工进行反洗钱培训等有效提高了公司员工的合规意识。

通过以上工作的开展，在本报告期内本基金运作过程中未发生违规情形，基金运作整体合法合规。在今后的工作中，本基金管理人承诺将一如既往的本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金持有人谋求最大利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，基金管理人严格执行基金估值控制流程，定期评估估值技术的合理性，每日将估值结果报托管银行复核后对外披露。参与估值流程的人员包括负责运营的副总经理以及投资研究、风险控制、金融工程和基金事务部门负责人，基金经理不参与估值流程。参与人员的相关工作经历均在五年以上。参与各方之间不存在任何重大利益冲突。已采用的估值技术相关参数或定价服务均来自独立第三方。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益每年至少分配一次，基金收益分配每年至多 4 次；全年基金收益分配比例不得低于年度基金可供分配收益的 60%；基金收益分配后每基金份额净值不低于面值。本基金于 2009 年 4 月 20 日实施了本年度第一次收益分配，每 10 份基金份额获得 0.47 元红利，于 2009 年 12 月 28 日实施了本年度第二次收益分配，每 10 份基金份额获得 0.30 元红利。截至本报告期末，基金可分配收益为 A 类：0.0794 元/份和 B 类：0.0725 元/份。

§ 5 托管人报告**5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明**

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告/半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、

准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

招商银行股份有限公司
2010 年 3 月 25 日

§ 6 审计报告

普华永道中天审字(2010)第 20170 号

友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金全体基金份额持有人:

我们审计了后附的友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金(以下简称“友邦华泰稳本增利基金”)的财务报表,包括 2009 年 12 月 31 日的资产负债表、2009 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注。

一、管理层对财务报表的责任

按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会允许的基金行业实务操作的有关规定编制财务报表是友邦华泰稳本增利基金的基金管理人友邦华泰基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括:

- (1) 设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报;
- (2) 选择和运用恰当的会计政策;
- (3) 作出合理的会计估计。

二、注册会计师的责任

我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范,计划和实施审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,我们考虑与财务报表编制相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。

我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。

三、审计意见

我们认为,上述财务报表已经按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制,在所有重大方面公允反映了友邦华泰稳本增利基金 2009 年 12 月 31 日的财务状况以及 2009 年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天
会计师事务所有限公司

注册会计师 薛 竞

中国 · 上海市

注册会计师 单 峰

2010 年 3 月 26 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：友邦华泰金字塔稳本增利债券型基金

报告截止日：2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2009 年 12 月 31 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	98,690,657.43	11,569,015.68
结算备付金		1,860,813.70	2,064,122.56
存出保证金		510,000.00	510,000.00
交易性金融资产	7.4.7.2	372,450,530.76	751,271,529.97
其中：股票投资		10,097,148.89	36,550,188.38
基金投资		-	-
债券投资		351,083,446.28	700,280,674.80
资产支持证券投资		11,269,935.59	14,440,666.79
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	1,778,008.16
应收利息	7.4.7.5	2,799,195.08	12,121,805.45
应收股利		-	-
应收申购款		127,199.80	3,289,613.96
递延所得税资产		-	-
其它资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		476,438,396.77	782,604,095.78
负债和所有者权益	附注号	本期末 2009 年 12 月 31 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-

交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		40,000,000.00	109,999,775.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		228,356.47	3,305,217.68
应付管理人报酬		263,961.67	393,216.39
应付托管费		75,417.62	112,347.57
应付销售服务费		45,901.57	81,989.33
应付交易费用	7.4.7.7	616,544.19	121,992.21
应交税费		577,311.60	85,200.00
应付利息		5,329.74	10,047.82
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其它负债	7.4.7.8	495,340.42	445,699.26
负债合计		42,308,163.28	114,555,485.26
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	402,132,543.96	610,639,133.45
未分配利润	7.4.7.10	31,997,689.53	57,409,477.07
所有者权益合计		434,130,233.49	668,048,610.52
负债和所有者权益总计		476,438,396.77	782,604,095.78

注：报告截止日 2009 年 12 月 31 日，基金份额总额为 402,132,543.96 份，其中 A 类基金份额净值 1.0823 元，A 类基金份额总额 240,664,049.11 份；B 类基金份额净值 1.0754 元，B 类基金份额总额 161,468,494.85 份。

7.2 利润表

会计主体：友邦华泰金字塔稳本增利债券型基金

本报告期：2009 年 01 月 01 日至 2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2009 年 01 月 01 日至 2009 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2008 年 01 月 01 日至 2008 年 12 月 31 日
一、收入		32,098,307.30	111,313,672.03
1. 利息收入		12,331,117.64	44,684,080.86
其中：存款利息收入	7.4.7.11	311,547.95	2,054,204.51
债券利息收入		11,559,223.19	40,456,446.25
资产支持证券利息收入		460,346.50	728,488.40
买入返售金融资产收入		-	1,444,941.70
其它利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		33,375,150.36	46,029,209.64
其中：股票投资收益	7.4.7.12	30,008,632.37	8,081,911.58
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	2,414,875.10	37,433,829.22
资产支持证券投资收益		-	-

衍生工具收益	7.4.7.14	-	202,032.91
股利收益	7.4.7.15	951,642.89	311,435.93
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-14,082,945.29	17,213,643.23
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其它收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	474,984.59	3,386,738.30
减：二、费用		8,301,684.49	19,993,464.15
1. 管理人报酬		3,144,320.14	9,097,971.20
2. 托管费		898,377.17	2,599,420.31
3. 销售服务费		712,546.29	1,336,614.05
4. 交易费用	7.4.7.18	2,805,724.52	666,528.45
5. 利息支出		558,452.41	6,051,781.58
其中：卖出回购金融资产支出		558,452.41	6,051,781.58
6. 其它费用	7.4.7.19	182,263.96	241,148.56
三、利润总额		23,796,622.81	91,320,207.88

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：友邦华泰金字塔稳本增利债券型基金

本报告期：2009 年 01 月 01 日 至 2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 01 月 01 日至 2009 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	610,639,133.45	57,409,477.07	668,048,610.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	23,796,622.81	23,796,622.81
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-208,506,589.49	-17,817,031.40	-226,323,620.89
其中：1.基金申购款	382,430,067.52	37,693,295.10	420,123,362.62
2.基金赎回款（以“-”号填列）	-590,936,657.01	-55,510,326.50	-646,446,983.51
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-31,391,378.95	-31,391,378.95
五、期末所有者权益（基金净值）	402,132,543.96	31,997,689.53	434,130,233.49
项目	上年度可比期间 2008 年 01 月 01 日至 2008 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计

一、期初所有者权益(基金净值)	129,313,489.43	2,276,753.37	131,590,242.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	91,320,207.88	91,320,207.88
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	481,325,644.02	-34,122,601.72	447,203,042.30
其中: 1. 基金申购款	2,401,821,008.96	28,419,794.06	2,430,240,803.02
2. 基金赎回款(以“-”号填列)	-1,920,495,364.94	-62,542,395.78	-1,983,037,760.72
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-2,064,882.46	-2,064,882.46
五、期末所有者权益(基金净值)	610,639,133.45	57,409,477.07	668,048,610.52

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1-7.4 财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人-陈国杰 主管会计工作负责人-房伟力 会计机构负责人-陈培

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金(原友邦华泰中短期债券投资基金)(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2006]第37号《关于同意友邦华泰中短期债券投资基金募集的批复》核准,由友邦华泰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《友邦华泰中短期债券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币5,652,942,702.72元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2006)第32号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《友邦华泰中短期债券投资基金基金合同》于2006年4月13日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为5,654,301,635.20份基金份额,其中认购资金利息折合1,358,932.48份基金份额。本基金的基金管理人为友邦华泰基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据本基金基金份额持有人大会审议通过的《关于友邦华泰中短期债券投资基金转型为友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金有关事项的议案》,并经中国证监会证监基金字[2007]第323号《关于核准友邦华泰中短期债券投资基金基金份额持有人大会有关变更基金类别决议的批复》,本基金的基金类别自2007年12月3日起由原中短期债券基金转型为普通债券型基金。《友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金基金合同》和《友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金托管协议》自2007年12月3日起生效,原《友邦华泰中短期债券投资基金基金合同》和《友邦华泰中短期债券投资基金托管协议》自同一起失效。

根据《友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金基金合同》和《友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,自2007年12月3日起,本基金根据申购费用和销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时分级收取前端申购费用但免收销售服务费的称为A类,而不收取前端申购费用只从本类别基金资产中计提销售服务费的称为B类。本基金A类、B类两种收费模式并存,由于基金费用的不同,

本基金 A 类基金份额和 B 类基金份额分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和实施转型后修订的《友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围自 2007 年 12 月 3 日起变更为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券、股票、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中，固定收益类资产(包括国债、金融债、企业债、可转换债券、资产支持证券、央行票据、债券回购、同业存款等)的比例不低于基金资产的 80%，投资于风险类资产(固定收益类资产以外的其它资产，包括股票、权证等)的比例不超过基金资产的 20%。此外，本基金可以参与一级市场新股申购，并持有因在一级市场申购所获得的股票以及因可转债转股所形成的股票，也可以直接投资于二级市场中的股票、权证等，还可以持有股票所派发的权证、可分离债券产生的权证。本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券(含政策性金融债、央行票据)不低于基金资产净值的 5%，持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%。本基金的转型后业绩比较基准为：中信标普全债指数 $\times$ 80%+一年期银行定期存款税后收益率 $\times$ 20%。

本财务报表由本基金的基金管理人友邦华泰基金管理有限公司于 2010 年 3 月 26 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其它有关规定的声明

本基金 2009 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2009 年 12 月 31 日的财务状况以及 2009 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(i) 金融资产的分类 金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。本基金目前持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资 and 衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入当期损益的金融资产在资产负债表以交易性金融资产列示。本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。(ii) 金融负债的分类 金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或起息日或上次除息日至购买日止的债券利息或资产支持证券利息，应当单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：(i)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。(ii)存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。(iii)当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

同一级别内的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分后的余额)。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。收益分配原则：1、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，B 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同，本基金同一类别内的每一基金份额享有同等分配权；2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金份额持有人可对 A 类、B 类基金份额分别选择不同的分红方式。选择采取红利再投资形式的，同一类别基金份额的分红资金将按分红实施日该类别的基金份额净值转成相应的同一类别的基金份额，红利再投资的份额免收前端申购费。同一投资者持有的同一基金的同一费用类别只能选择一种分红方式，如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，则注册登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准；3、基金当期收益先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；4、如果基金当期出现亏损，则不进行收益分配；5、基金收益分配后每基金份额净值不低于面值；6、在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益每年至少分配一次，基金收益分配每年至多 4 次；7、全年基金收益分配比例不得低于年度基金可供分配收益的 60%；若基金合同生效不满 3 个月，收益可不分配；8、法律、法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.4.12 其它重要的会计政策和会计估计

(1) 计量属性

本基金除特别说明对金融资产和金融负债采用公允价值等作为计量属性之外，一般采用历史成本计量。

(2) 重要会计估计及其关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- (2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入, 由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税, 暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入, 由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额, 依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税, 暂不征收企业所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税, 买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2009 年 12 月 31 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
活期存款	98,690,657.43	11,569,015.68
定期存款	-	-
其中: 存款期限 1-3 个月	-	-
其它存款	-	-
合计:	98,690,657.43	11,569,015.68

7.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目		本期末 2009 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		6,350,971.56	10,097,148.89	3,746,177.33
债券	交易所市场	142,447,849.38	142,678,446.28	230,596.90
	银行间市场	208,559,483.15	208,405,000.00	-154,483.15
	合计	351,007,332.53	351,083,446.28	76,113.75
资产支持证券		11,269,935.59	11,269,935.59	-
其它		-	-	-
合计		368,628,239.68	372,450,530.76	3,822,291.08
项目		上年度末 2008 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		44,090,193.20	36,550,188.38	-7,540,004.82
债券	交易所市场	123,859,103.92	131,605,174.80	7,746,070.88
	银行间市场	550,976,329.69	568,675,500.00	17,699,170.31
	合计	674,835,433.61	700,280,674.80	25,445,241.19
资产支持证券		14,440,666.79	14,440,666.79	-
其它		-	-	-
合计		733,366,293.60	751,271,529.97	17,905,236.37

注: 债券投资中银行间同业市场交易债券均按现金流量折现法估值, 具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限公司独立提供。采用该估值技术的银行间同业市场交易债券于本年度利润表中确认的公允价值变动收益为 -17,853,653.46 元 (2008 年度: 17,699,170.31 元)。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

截至本报告期末, 本基金未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

截至本报告期末，本基金未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

截至本报告期末，本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 12 月 31 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	23,778.12	2,377.41
应收定期存款利息	-	-
应收其它存款利息	-	-
应收结算备付金利息	716.43	1,001.04
应收债券利息	2,703,785.38	11,960,499.71
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	661.14
其它	70,915.15	157,266.15
合计	2,799,195.08	12,121,805.45

7.4.7.6 其它资产

截至本报告期末，本基金未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 12 月 31 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	611,774.99	107,725.21
银行间市场应付交易费用	4,769.20	14,267.00
合计	616,544.19	121,992.21

7.4.7.8 其它负债

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 12 月 31 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	250,000.00	250,000.00
应付赎回费	290.92	5,699.26
预提审计费	45,000.00	90,000.00
预提信息披露费	200,000.00	100,000.00
其他应付款	49.50	0
合计	495,340.42	445,699.26

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

A 级		
项目	本期 2009 年 01 月 01 日至 2009 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	317,507,501.75	317,507,501.75
本期申购	269,242,068.14	269,242,068.14
本期赎回	-346,085,520.78	-346,085,520.78
本期末	240,664,049.11	240,664,049.11

B 级		
项目	本期 2009 年 01 月 01 日至 2009 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	293,131,631.70	293,131,631.70
本期申购	113,187,999.38	113,187,999.38
本期赎回	-244,851,136.23	-244,851,136.23
本期末	161,468,494.85	161,468,494.85

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

A 级			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	22,964,391.95	7,368,639.96	30,333,031.91
本期利润	18,775,252.82	-7,520,685.81	11,254,567.01
本期基金份额交易产生的变动数	-7,038,392.61	849,359.56	-6,189,033.05
其中：基金申购款	25,617,751.61	238,743.64	25,856,495.25
基金赎回款	-32,656,144.22	610,615.92	-32,045,528.30
本期已分配利润	-15,582,897.49	-	-15,582,897.49
本期末	19,118,354.67	697,313.71	19,815,668.38

B 级			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	20,284,627.35	6,791,817.81	27,076,445.16
本期利润	19,104,315.28	-6,562,259.48	12,542,055.80
本期基金份额交易产生的变动数	-11,869,564.96	241,566.61	-11,627,998.35
其中：基金申购款	11,255,319.78	581,480.07	11,836,799.85
基金赎回款	-23,124,884.74	-339,913.46	-23,464,798.20
本期已分配利润	-15,808,481.46	-	-15,808,481.46
本期末	11,710,896.21	471,124.94	12,182,021.15

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 01 月 01 日至 2009 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2008 年 01 月 01 日至 2008 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	280,985.20	1,991,683.65
定期存款利息收入	-	-

其它存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	18,305.58	62,520.86
其它	12,257.17	-
合计	311,547.95	2,054,204.51

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2009年01月01日至 2009年12月31日	上年度可比期间 2008年01月01日至 2008年12月31日
卖出股票成交总额	942,742,609.57	164,315,402.53
减：卖出股票成本总额	912,733,977.20	156,233,490.95
买卖股票差价收入	30,008,632.37	8,081,911.58

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2009年01月01日至 2009年12月31日	上年度可比期间 2008年01月01日至 2008年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,673,105,220.88	3,627,164,741.06
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,641,816,761.78	3,531,145,603.79
减：应收利息总额	28,873,584.00	58,585,308.05
债券投资收益	2,414,875.10	37,433,829.22

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2009年01月01日至 2009年12月31日	上年度可比期间 2008年01月01日至 2008年12月31日
卖出权证成交金额	-	36,157,942.44
减：卖出权证成本总额	-	35,955,909.53
买卖权证差价收入	-	202,032.91

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2009年01月01日至 2009年12月31日	上年度可比期间 2008年01月01日至 2008年12月31日
股票投资产生的股利收益	951,642.89	311,435.93
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	951,642.89	311,435.93

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2009年01月01日至 2009年12月31日	上年度可比期间 2008年01月01日至 2008年12月31日
1. 交易性金融资产	-14,082,945.29	17,233,995.22
——股票投资	11,286,182.15	-7,540,004.82
——债券投资	-25,369,127.44	24,774,000.04
——资产支持证券投资	-	-
2. 衍生工具	-	-20,351.99
——权证投资	-	-20,351.99
3. 其它	-	-
合计	-14,082,945.29	17,213,643.23

7.4.7.17 其它收入

单位：人民币元

项目	本期 2009年01月01日至 2009年12月31日	上年度可比期间 2008年01月01日至 2008年12月31日
基金赎回费收入	444,051.60	3,355,061.54
转换费收入	18,524.04	31,674.10
其他收入	12,408.95	2.66
合计	474,984.59	3,386,738.30

注：1、本基金自 2007 年 12 月 3 日起转型成为友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金，赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 40% 归入基金财产。2、本基金的转换费由转出基金赎回费用及基金申购补差费用构成，其中赎回费用的 40% 的部分归入基金财产。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2009年01月01日至 2009年12月31日	上年度可比期间 2008年01月01日至 2008年12月31日
交易所市场交易费用	2,790,542.02	636,528.45
银行间市场交易费用	15,182.50	30,000.00
合计	2,805,724.52	666,528.45

7.4.7.19 其它费用

单位：人民币元

项目	本期 2009年01月01日至 2009年12月31日	上年度可比期间 2008年01月01日至 2008年12月31日
审计费用	45,000.00	90,000.00
信息披露费	100,000.00	100,000.00
基金持有人大会费	-	-

其他费用	37,263.96	51,148.56
合计	182,263.96	241,148.56

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
友邦华泰基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记人、基金直销机构
招商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
AIG Global Investment Corp.(AIGGIC)	基金管理人的股东
华泰证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
苏州新区高新技术产业股份有限公司	基金管理人的股东
华泰联合证券有限责任公司(“华泰联合证券”)	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司、基金代销机构

注：1、关联方与基金进行的关联交易均在正常业务范围内按照一般商业条款而订立的。

2、根据中国证监会证监许可[2009]921号《关于核准联合证券有限责任公司变更公司章程重要条款的批复》批准，“联合证券有限责任公司”的名称于2009年9月17日变更为“华泰联合证券有限责任公司”。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2009年01月01日至2009年12月31日		上年度可比期间 2008年01月01日至2008年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
华泰证券股份有限公司	1,793,859,696.17	100.00%	313,380,752.52	100.00%

7.4.10.1.2 权证交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2009年01月01日至2009年12月31日		上年度可比期间 2008年01月01日至2008年12月31日	
	成交金额	占当期权证 成交总额的比例	成交金额	占当期权证 成交总额的比例
华泰证券股份有限公司	-	-	36,157,942.44	100.00%

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2009年01月01日至2009年12月31日
-------	-------------------------------

	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例
华泰证券股份有限公司	1,500,929.97	100.00%	611,774.99	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2008年01月01日至2008年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例
华泰证券股份有限公司	263,230.88	100.00%	107,725.21	100.00%

注：上述佣金在基金转型之前按债券和回购交易量的十万分之一点五计算，以扣除由交易所或中国证券登记结算有限责任公司收取的费用，以及由券商承担的债券和回购交易的证券结算风险基金后的净额列示，转型之后按股票交易量的千分之一计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。本基金未租用其他券商专用交易单元。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2009年01月01日至 2009年12月31日	上年度可比期间 2008年01月01日至 2008年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,144,320.14	9,097,971.20
其中：应支付给销售机构的客户 维护费	493,949.02	898,914.68

注：转型前，本基金应支付基金管理人报酬，按前一日基金资产净值的 0.45% 的年费率计提。转型后，本基金应支付基金管理人报酬，按前一日基金资产净值的 0.70% 的年费率计提，计算方法如下： $H = E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$ H 为每日应支付的管理人报酬 E 为前一日的基金资产净值 基金管理人报酬每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2009年01月01日至 2009年12月31日	上年度可比期间 2008年01月01日至 2008年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	898,377.17	2,599,420.31

注：转型前，本基金应支付基金托管人托管费，按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。转型后，本基金应支付基金托管人托管费，按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提，计算方法如下： $H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$ H 为每日应支付的托管费 E 为前一日的基金资产净值 基金托管费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

7.4.10.2.3 销售服务费

金额单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方 名称	本期 2009年01月01日至2009年12月31日
--------------------	-------------------------------

	当期应支付的销售服务费		
	A 级	B 级	合计
友邦华泰基金管理有限公司	-	33,310.38	33,310.38
招商银行股份有限公司	-	78,398.00	78,398.00
华泰证券股份有限公司	-	197,826.89	197,826.89
华泰联合证券有限责任公司	-	1,907.13	1,907.13
合计	-	311,442.40	311,442.40
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2008 年 01 月 01 日至 2008 年 12 月 31 日		
	当期应支付的销售服务费		
	A 级	B 级	合计
友邦华泰基金管理有限公司	-	67,132.25	67,132.25
招商银行股份有限公司	-	91,917.91	91,917.91
华泰证券股份有限公司	-	332,251.78	332,251.78
华泰联合证券有限责任公司	-	10,478.93	10,478.93
合计	-	501,780.87	501,780.87

注：转型前，本基金应支付销售机构的销售服务费，按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。转型后，本基金A类基金份额不再计提销售服务费，B类基金份额应支付销售机构的销售服务费，按前一日基金资产净值的0.30%的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H为每日B类基金份额应支付的销售服务费

E为前一日的B类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人支付给各基金销售机构。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2009 年 01 月 01 日至 2009 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
招商银行股份有限公司	-	120,416,101.37	-	-	-	-
上年度可比期间 2008 年 01 月 01 日至 2008 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
招商银行股份有限公司	30,195,416.07	48,810,752.74	-	-	645,600,000.00	408,585.21

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

A类		
项目	本期 2009 年 01 月 01 日至	上年度可比期间 2008 年 01 月 01 日至

	2009 年 12 月 31 日	2008 年 12 月 31 日
基金合同生效日持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-

B类		
项目	本期 2009 年 01 月 01 日至 2009 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2008 年 01 月 01 日至 2008 年 12 月 31 日
基金合同生效日持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	39,849,573.89	-
期间申购/买入总份额	-	39,849,573.89
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	10,000,000.00	-
期末持有的基金份额	29,849,573.89	39,849,573.89
期末持有的基金份额占基金总份额比例	7.42%	6.53%

注：1、友邦华泰基金管理有限公司于2009年1月9日通过华泰证券股份有限公司赎回友邦华泰金字塔稳本增利债券型基金B类(基金代码460003) 1000万元，无赎回费。

2、友邦华泰基金管理有限公司于2008年1月9日通过华泰证券股份有限公司申购友邦华泰金字塔稳本增利债券型基金B类(基金代码460003) 1000万元，无申购费。

3、友邦华泰基金管理有限公司于2008年1月28日通过华泰证券股份有限公司申购友邦华泰金字塔稳本增利债券型基金B类(基金代码460003) 3000万元，无申购费。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

A类				
关联方名称	本期末 2009 年 12 月 31 日		上年度末 2008 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
AIG Global Investment Corp.(AIGGIC)	-	-	102,513,013.01	16.79%

B类

关联方名称	本期末 2009 年 12 月 31 日		上年度末 2008 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
AIG Global Investment Corp.(AIGGIC)	-	-	-	-

注：基金管理人的股东 AIG Global Investment Corp.(AIGGIC)通过合格境外机构投资者(QFII)持有本基金 A 类份额，申购费用参照基金管理人公布的费率。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2009 年 01 月 01 日至 2009 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2008 年 01 月 01 日至 2008 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	98,690,657.43	280,985.20	11,569,015.68	1,991,683.65

注：本报告期，基金托管人招商银行股份有限公司保管的银行存款按银行间同业存款利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未参与关联方承销证券。

7.4.10.7 其它关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——A 级

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份额分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2009-04-20	-	2009-04-20	0.47	3,088,942.89	5,281,161.97	8,370,104.86	-
2	2009-12-28	-	2009-12-28	0.30	6,936,126.28	276,666.35	7,212,792.63	-
合计	-	-	-	0.77	10,025,069.17	5,557,828.32	15,582,897.49	-

利润分配情况——B 级

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份额分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2009-04-20	-	2009-04-20	0.47	7,825,770.06	3,182,115.58	11,007,885.64	-

2	2009-12-28	-	2009-12-28	0.30	3,357,535.93	1,443,059.89	4,800,595.82	-
合计	-	-	-	0.77	11,183,305.99	4,625,175.47	15,808,481.46	-

7.4.12 期末（2009 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002328	新朋股份	2009-12-22	2010-03-30	新发流通受限	19.38	26.55	97,087.00	1,881,546.06	2,577,659.85	.
300027	华谊兄弟	2009-10-19	2010-02-01	新发流通受限	28.58	55.43	29,714.00	849,226.12	1,647,047.02	.
002307	北新路桥	2009-11-05	2010-02-11	新发流通受限	8.58	27.40	60,106.00	515,709.48	1,646,904.40	.
002308	威创股份	2009-11-18	2010-03-01	新发流通受限	23.80	31.83	31,977.00	761,052.60	1,017,827.91	.
002326	永太科技	2009-12-15	2010-03-22	新发流通受限	20.00	31.27	28,246.00	564,920.00	883,252.42	.
002332	仙琚制药	2009-12-30	2010-04-12	新发流通受限	8.20	8.20	97,147.00	796,605.40	796,605.40	.
002305	南国置业	2009-10-29	2010-02-08	新发流通受限	12.30	19.57	37,013.00	455,259.90	724,344.41	.
002315	焦点科技	2009-12-01	2010-03-09	新发流通受限	42.00	69.18	10,186.00	427,812.00	704,667.48	.
601117	中国化学	2009-12-29	2010-01-07	新发流通受限	5.43	5.43	13,000.00	70,590.00	70,590.00	.
300041	回天胶业	2009-12-28	2010-01-08	新发流通受限	36.40	36.40	500.00	18,200.00	18,200.00	.
002329	皇氏乳业	2009-12-25	2010-01-06	新发流通受限	20.10	20.10	500.00	10,050.00	10,050.00	.

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌的股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金银行间市场债券正回购余额为 0。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 40,000,000.00 元，于 2010 年 1 月 4 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只主动管理的债券型证券投资基金，属于较低风险品种。本基金投资的金融工具主要包括债券投资和股票投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金”的风险收益目标。本基金的基金管理人建立的风险管理体系由“组织、制度、流程和报告”等四个方面构成。组织是指由公司总经理领导，以风险控制委员会为核心，由督察长、风险管理部、法律监察部组成的风险管理机构，它是风险管理体系的运作基础；制度是指风险管理相关的规章制度，是对组织职能及其工作流程等的具体规定；流程是风险管理的工作流程，它详细规定了各部门之间风险管理工作的内容和程序；报告是对流程的必要反映和记录，既是风险管理工作的重要环节，也是对风险管理工作的总结和披露。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性

分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存在本基金的托管行招商银行，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金债券投资和资产支持证券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2009 年 12 月 31 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
A-1	9,994,000.00	71,065,000.00
未评级	69,769,000.00	58,803,000.00
合计	79,763,000.00	129,868,000.00

注：未评级的债券均为央行票据。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2009 年 12 月 31 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
AAA	18,449,443.19	14,440,666.79
AA+	24,145,650.98	-
AA	17,427,456.00	-
AA-	16,005,000.00	-
未评级	206,562,831.70	570,412,674.80
合计	282,590,381.87	584,853,341.59

注：1、上述评级包括债券投资及资产支持证券投资，其中资产支持证券采用发行评级；

2、未评级的债券均为国债、央行票据及政策性金融债。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理

人在基金合同中设计了巨额赎回条款,约定在非常情况下赎回申请的处理方式,控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险,有效保障基金持有人利益。针对投资品种变现的流动性风险,本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求,对流动性指标进行持续的监测和分析,包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外,其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。除卖出回购金融资产按余额计息外,本基金所持有的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险,适用于本基金的市场风险包括利率风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险,其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控,并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、债券投资及资产支持证券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位:人民币元

本期末 9 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	6 个月 以内	3 个月-1 年	6 个月 -1 年	1 年 以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
银行存款	98,690,657.43	-	-	-	-	-	-	-	-	98,690,657
结算备付金	1,860,813.70	-	-	-	-	-	-	-	-	1,860,813
保证金	260,000.00	-	-	-	-	-	-	-	250,000.00	510,000
货币性金融资产	69,769,000.00	60,064,000.00	-	51,425,935.59	-	-	102,160,990.28	78,933,456.00	10,097,148.89	372,450,530
证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
利息	-	-	-	-	-	-	-	-	2,799,195.08	2,799,195
申购款	127,199.80	-	-	-	-	-	-	-	-	127,199
总计	170,707,670.93	60,064,000.00	-	51,425,935.59	-	-	102,160,990.28	78,933,456.00	13,146,343.97	476,438,396
卖出回购金融资产	40,000,000.00	-	-	-	-	-	-	-	0	40,000,000
赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	228,356.47	228,356
管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	263,961.67	263,961
托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	75,417.62	75,417
交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	616,544.19	616,544
销售服务费	-	-	-	-	-	-	-	-	45,901.57	45,901

利息	-	-	-	-	-	-	-	-	5,329.74	5,329
税费	-	-	-	-	-	-	-	-	577,311.60	577,311
负债	-	-	-	-	-	-	-	-	495,340.42	495,340
总计	40,000,000.00	-	-	-	-	-	-	-	2,308,163.28	42,308,163
敏感度缺口	130,707,670.93	60,064,000.00	-	51,425,935.59	-	-	102,160,990.28	78,933,456.00	10,838,180.69	434,130,233
年度末 3 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	6 个月 以内	3 个月-1 年	6 个月 -1 年	1 年 以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
存款	11,569,015.68	-	-	-	-	-	-	-	-	11,569,015.68
备付金	2,064,122.56	-	-	-	-	-	-	-	-	2,064,122.56
保证金	260,000.00	-	-	-	-	-	-	-	250,000.00	510,000.00
性金融资产	20,318,000.00	20,316,000.00	-	99,235,642.59	-	-	367,261,699.00	207,590,000.00	36,550,188.38	751,271,522.57
证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	1,778,008.16	1,778,008.16
利息	-	-	-	-	-	-	-	-	12,121,805.45	12,121,805.45
申购款	3,289,613.96	-	-	-	-	-	-	-	-	3,289,613.96
总计	37,500,752.20	20,316,000.00	-	99,235,642.59	-	-	367,261,699.00	207,590,000.00	50,700,001.99	782,604,097.34
回购金融资产	109,999,775.00	-	-	-	-	-	-	-	-	109,999,775.00
赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	3,305,217.68	3,305,217.68
管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	393,216.39	393,216.39
托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	112,347.57	112,347.57
销售服务费	-	-	-	-	-	-	-	-	81,989.33	81,989.33
交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	121,992.21	121,992.21
税费	-	-	-	-	-	-	-	-	85,200.00	85,200.00
利息	-	-	-	-	-	-	-	-	10,047.82	10,047.82
负债	-	-	-	-	-	-	-	-	445,699.26	445,699.26
总计	109,999,775.00	-	-	-	-	-	-	-	4,555,710.26	114,555,485.26
敏感度缺口	-72,499,022.80	20,316,000.00	-	99,235,642.59	-	-	367,261,699.00	207,590,000.00	46,144,291.73	668,048,611.73

注：各期限分类的标准按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末（2009年12月31日）	上年度末（2008年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	增加约 186.40	增加约 866.57
	市场利率上升 25 个基点	下降约 183.97	下降约 849.28

7.4.13.4.2 其它价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间同业市场交易的债券，所面临的其

他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的 80%，股票等权益类工具的投资比例不超过基金资产的 20%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。于 2009 年 12 月 31 日，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

7.4.13.4.2.1 其它价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 12 月 31 日		上年度末 2008 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	10,097,148.89	2.33	36,550,188.38	5.47
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其它	-	-	-	-
合计	10,097,148.89	2.33	36,550,188.38	5.47

7.4.13.4.2.2 其它价格风险的敏感性分析

截至 2009 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 2.33%(2008 年 12 月 31 日：5.47%)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响(2008 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.3 采用风险价值法管理风险

截至本报告期末，本基金持有的股票资产为基金资产净值的 2.33%，占比较小，因此本基金未采用风险价值法管理风险。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其它事项

无。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	10,097,148.89	2.12
	其中：股票	10,097,148.89	2.12
2	固定收益投资	362,353,381.87	76.05
	其中：债券	351,083,446.28	73.69

	资产支持证券	11,269,935.59	2.37
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	100,551,471.13	21.10
6	其它各项资产	3,436,394.88	0.72
7	合计	476,438,396.77	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	4,285,767.67	0.99
C0	食品、饮料	10,050.00	0.00
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	901,452.42	0.21
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	2,577,659.85	0.59
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	796,605.40	0.18
C99	其它制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,717,494.40	0.40
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	1,722,495.39	0.40
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	724,344.41	0.17
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	1,647,047.02	0.38
M	综合类	-	-
	合计	10,097,148.89	2.33

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002328	新朋股份	97,087.00	2,577,659.85	0.59
2	300027	华谊兄弟	29,714.00	1,647,047.02	0.38
3	002307	北新路桥	60,106.00	1,646,904.40	0.38
4	002308	威创股份	31,977.00	1,017,827.91	0.23
5	002326	永太科技	28,246.00	883,252.42	0.20
6	002332	仙琚制药	97,147.00	796,605.40	0.18
7	002305	南国置业	37,013.00	724,344.41	0.17
8	002315	焦点科技	10,186.00	704,667.48	0.16
9	601117	中国化学	13,000.00	70,590.00	0.02
10	300041	回天胶业	500.00	18,200.00	0.00
11	002329	皇氏乳业	500.00	10,050.00	0.00

8.4 报告期内权益投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000878	云南铜业	52,502,116.27	7.86
2	600030	中信证券	41,875,988.80	6.27
3	000629	攀钢钢钒	39,293,500.00	5.88
4	600028	中国石化	33,961,607.93	5.08
5	601328	交通银行	29,694,805.06	4.45
6	000060	中金岭南	29,487,623.58	4.41
7	600837	海通证券	24,873,852.18	3.72
8	601666	平煤股份	24,321,248.53	3.64
9	601628	中国人寿	21,341,771.88	3.19
10	600362	江西铜业	20,376,690.31	3.05
11	000568	泸州老窖	16,545,504.86	2.48
12	002024	苏宁电器	15,535,815.65	2.33
13	000001	深发展 A	15,022,774.54	2.25
14	000537	广宇发展	14,777,527.70	2.21
15	000012	南 玻 A	14,742,892.50	2.21
16	601601	中国太保	14,362,241.20	2.15
17	600019	宝钢股份	14,359,875.67	2.15
18	600005	武钢股份	14,339,214.79	2.15

19	600887	*ST 伊利	13,606,758.73	2.04
20	601699	潞安环能	13,244,966.50	1.98

注：不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000878	云南铜业	55,113,371.26	8.25
2	000629	攀钢钢钒	45,862,480.13	6.87
3	600030	中信证券	43,350,506.49	6.49
4	600028	中国石化	34,015,109.28	5.09
5	000060	中金岭南	31,736,145.46	4.75
6	601328	交通银行	28,700,382.88	4.30
7	600837	海通证券	26,919,808.22	4.03
8	601666	平煤股份	25,583,647.29	3.83
9	600362	江西铜业	24,656,134.97	3.69
10	601628	中国人寿	21,183,766.81	3.17
11	000001	深发展 A	19,136,492.40	2.86
12	000568	泸州老窖	17,998,585.55	2.69
13	002024	苏宁电器	17,111,963.50	2.56
14	601699	潞安环能	16,146,050.12	2.42
15	000012	南玻 A	15,426,673.11	2.31
16	600000	浦发银行	13,743,022.48	2.06
17	600089	特变电工	13,599,657.21	2.04
18	601601	中国太保	13,569,521.73	2.03
19	600219	南山铝业	13,202,187.03	1.98
20	601668	中国建筑	12,729,288.06	1.91

注：不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	875,953,828.50
卖出股票收入（成交）总额	942,742,609.57

注：不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	77,920,831.70	17.95
2	央行票据	69,769,000.00	16.07
3	金融债券	128,642,000.00	29.63
	其中：政策性金融债	128,642,000.00	29.63
4	企业债券	64,757,614.58	14.92
5	企业短期融资券	9,994,000.00	2.30
6	可转债	-	-
7	其它	-	-
8	合计	351,083,446.28	80.87

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	080404	08 农发 04	500,000.00	50,075,000.00	11.53
2	0901049	09 央行票据 49	500,000.00	49,835,000.00	11.48
3	010203	02 国债(3)	391,490.00	39,669,681.70	9.14
4	080312	08 进出 12	400,000.00	38,416,000.00	8.85
5	010112	21 国债(12)	373,000.00	38,251,150.00	8.81

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	119004	澜 电 03	100,000.00	10,001,642.59	2.30
2	119005	浦建收益	130,000.00	1,268,293.00	0.29

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

8.9.2

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

8.9.3 期末其它各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	510,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,799,195.08
5	应收申购款	127,199.80
6	其它应收款	-
7	待摊费用	-
8	其它	-
9	合计	3,436,394.88

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002328	新朋股份	2,577,659.85	0.59	网下中签新股未上市
2	300027	华谊兄弟	1,647,047.02	0.38	网下中签新股未上市
3	002307	北新路桥	1,646,904.40	0.38	网下中签新股未上市
4	002308	威创股份	1,017,827.91	0.23	网下中签新股未上市
5	002326	永太科技	883,252.42	0.20	网下中签新股未上市
6	002332	仙琚制药	796,605.40	0.18	网下中签新股未上市
7	002305	南国置业	724,344.41	0.17	网下中签新股未上市
8	002315	焦点科技	704,667.48	0.16	网下中签新股未上市
9	601117	中国化学	70,590.00	0.02	网上中签新股未上市
10	300041	回天胶业	18,200.00	0.00	网上中签新股未上市

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有人户 数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
A 级	1,290	186,561.28	204,736,665.51	85.07%	35,927,383.60	14.93%
B 级	6,018	26,830.92	31,127,874.41	19.28%	130,340,620.44	80.72%
合计	7,308	55,026.35	235,864,539.92	58.65%	166,268,004.04	41.35%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	B 级	4,683.15	0.00%
	合计	4,683.15	0.00%

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	A 类	B 类
基金合同生效日（2007 年 12 月 3 日） 基金份额总额	131,333,847.25	-
本报告期期初基金份额总额	317,507,501.75	293,131,631.7
本报告期基金总申购份额	269,242,068.14	113,187,999.38
减：本报告期基金总赎回份额	346,085,520.78	244,851,136.23
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	240,664,049.11	161,468,494.85

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。本报告期基金应支付给普华永道中天会计师事务所有限公司的报酬为45,000.00元人民币，该事务所已向本基金提供了4年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票 成交总额的比例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
华泰证券	2	1,793,859,696.17	100.00%	1,500,929.97	100.00%	-

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准

1) 资金雄厚，信誉良好。

2) 财务状况良好，经营行为规范，最近一年未因重大违规行为而受到有关管理机关的处罚。

3) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求。

4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务。

5) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时、定期、全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。

2、选择代理证券买卖的证券经营机构的程序 基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订交易单元租用协议和证券研究服务协议。

3、本报告期内，无变更租用证券公司交易单元的情况。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其它证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华泰证券	450,186,504.88	100.00%	600,000,000.00	100.00%	-	-

11.8 其它重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	友邦华泰基金管理有限公司参加中国工商银行“2010 倾心回馈”基金定投优惠活动的公告	上海证券报	2009-12-31
2	友邦华泰基金管理有限公司关于延长在中信建投证券有限责任公司的基金定期定额申购费率优惠活动的公告	上海证券报	2009-12-31
3	友邦华泰基金管理有限公司关于延长在中国农业银行的基金定期定额申购费率优惠活动的公告	上海证券报	2009-12-31
4	友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金第九次分红公告	上海证券报	2009-12-25
5	友邦华泰基金管理有限公司关于增加华龙证券有限责任公司和中国建银投资证券有限责任公司为代销机构的公告	上海证券报	2009-12-10
6	友邦华泰基金管理有限公司关于增加爱建证券有限责任公司为代销机构的公告	上海证券报	2009-11-20
7	友邦华泰基金管理有限公司关于增加信达证券股份有限公司为代销机构的公告	上海证券报	2009-11-18
8	友邦华泰关于调整建行卡网上交易申购费率的公告	上海证券报	2009-11-17
9	友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金 2009 年第三季度报告	上海证券报	2009-10-27
10	友邦华泰基金管理有限公司关于旗下基金持有的上海医药股票恢复采用收盘价估值的提示公告	上海证券报	2009-10-20
11	友邦华泰关于旗下基金参与创业板市场投资的公告	上海证券报	2009-09-24
12	友邦华泰关于参加第一创业证券开放式基金网上申购费率优惠活动的公告	上海证券报	2009-09-15
13	友邦华泰关于参加农业银行网上银行开放式基金申购费率优惠活动的公告	上海证券报	2009-09-08
14	友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金	上海证券报	2009-08-26

	2009 年半年度报告摘要		
15	友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金 2009 年半年度报告	上海证券报	2009-08-26
16	友邦华泰开通网上交易定期定额转换业务的公告	上海证券报	2009-08-25
17	友邦华泰基金关于增加华宝证券和天相投资顾问 有限公司为代销机构的公告	上海证券报	2009-08-11
18	友邦华泰关于增加广发华福证券为代销机构并参 加其网上交易费率优惠的公告	上海证券报	2009-08-05
19	友邦华泰关于旗下基金持有的“盐湖钾肥”恢复 采用收盘价估值的公告	上海证券报	2009-07-28
20	友邦华泰关于旗下基金资产估值方法调整的公告	上海证券报	2009-07-24
21	友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金 2009 年第二季度报告	上海证券报	2009-07-20
22	友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金更 新的招募说明书	上海证券报	2009-07-16
23	友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金更 新的招募说明书（摘要）	上海证券报	2009-07-16
24	友邦华泰参加邮储银行定期定额投资优惠期间延 长的公告	上海证券报	2009-06-26
25	友邦华泰参加深发展网银定投并开展定投申购费 率优惠活动的公告	上海证券报	2009-06-05
26	友邦华泰稳本增利债券型基金关于调整赎回费率 的公告	上海证券报	2009-06-03
27	友邦华泰关于旗下基金持有的长江电力股票恢复 采用收盘价估值的提示公告	上海证券报	2009-05-19
28	友邦华泰参加中国银行网上银行费率优惠及定期 定额申购费率优惠活动的公告	上海证券报	2009-05-04
29	友邦华泰关于参加联合证券实行开放式基金定期 定额申购费率优惠活动的公告	上海证券报	2009-04-30
30	友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金 2009 年第一季度报告	上海证券报	2009-04-22
31	友邦华泰基金管理有限公司关于部分赎回持有的 友邦华泰增利基金 B 类份额的公告	上海证券报	2009-04-16
32	友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金第 八次分红公告	上海证券报	2009-04-16
33	友邦华泰参加工商银行个人网银基金申购费率优 惠活动的公告	上海证券报	2009-03-31
34	友邦华泰基金管理有限公司关于变更注册地址的 公告	上海证券报	2009-03-31
35	友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金 2008 年年度报告	上海证券报	2009-03-28
36	友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金 2008 年年度报告摘要	上海证券报	2009-03-28

37	友邦华泰参加华夏银行基金定投申购费率优惠活动的公告	上海证券报	2009-02-27
38	友邦华泰关于参加中国工商银行“基智定投”营销活动的公告	上海证券报	2009-02-25
39	友邦华泰关于参加交通银行网上交易优惠活动的公告	上海证券报	2009-02-25
40	友邦华泰基金关于在东海证券开办基金定期定额业务的公告	上海证券报	2009-02-21
41	友邦华泰关于提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	上海证券报	2009-02-05
42	友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金 2008 年第四季度报告	上海证券报	2009-01-21
43	友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金更新的招募说明书(摘要)	上海证券报	2009-01-15
44	友邦华泰关于在深圳发展银行开办基金定期定额业务并参加定投申购优惠活动的公告	上海证券报	2009-01-10
45	友邦华泰关于调整建行网上交易申购费率的公告	上海证券报	2009-01-06
46	友邦华泰关于旗下基金持有的“盐湖钾肥”恢复采用收盘价估值的公告	上海证券报	2009-01-06

§ 12 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1、中国证监会批准友邦华泰中短期债券投资基金募集以及转型为友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金的文件

2、《友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金基金合同》

3、《友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金招募说明书》

4、《友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金托管协议》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照

6、友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金的公告

13.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。投资者对本报告如有疑问，可咨询基金管理人友邦华泰基金管理有限公司。 客户服务热线：400-888-0001（免长途费）

021-3878 4638 公司网址：www.aig-huatai.com